

## 中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划

### 法律文件变更提示公告

尊敬的投资者：

感谢您长期以来对中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划（以下简称“中金指数增强 2 期”）的支持！为满足《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、中国证券监督管理委员会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》的规定，中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）作为中金指数增强 2 期的管理人，经与托管人中国银行股份有限公司北京市分行协商一致，决定变更《中金指数增 2 期（中证 500）集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）、《中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、《中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称《风险揭示书》）相应条款。《资产管理合同》、《说明书》、《风险揭示书》（以下简称“本合同”）具体变更内容请参阅附件。

委托人不同意本次合同变更的，可以于 2019 年 6 月 21 日、6 月 24 日 6 月 27 日提交退出申请，由于本次合同变更造成下层投资产品的终止清算，赎回款项的支付将延迟到 T(赎回确认日)+9 工作日支付。本次合同变更将于 2019 年 7 月 11 日起生效。届时，中金公司将通过中金公司网站公告变更后的《资产管理合同》、《说明书》及《风险揭示书》。委托人无需就本次合同变更与中金公司、托管人另行签署变更后的《资产管理合同》或关于本次合同变更的补充协议，经中金公司公告的本次合同变更内容自本合同变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询中金集合计划客服热线：

8008108802（固话免费）

010-65050105（直线）

中国国际金融有限公司

2019 年 6 月 18 日

附件：《资产管理合同》、《说明书》及《风险揭示书》变更明细表



附件：《资产管理合同》、《说明书》及《风险揭示书》变更明细表

《中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划集合资产管理合同》变更明细表

变更前	变更后
投资者承诺书	
<p>本人 / 单位作为符合法律法规及中国证券监督管理委员会规定的集合资产管理计划合格投资者（即个人投资者个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币，机构投资者机构净资产不低于 1000 万元人民币，或为监管机构认可的其他合格投资者），具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源及用途合法，符合有关反洗钱法律、法规的要求。</p> <p>适用于个人投资者：</p> <p>本人没有用筹集的他人资金参与集合资产管理计划。</p> <p>适用于机构投资者：</p> <p>本单位没有非法汇集他人资金投资集合资产管理计划，若本单位以筹集资金参与集合资产管理计划，将向管理人提供合法筹集的证明文件。</p> <p>本人 / 单位在参与贵公司发起设立的集合资产管理计划的投资过程中，如果因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述所产生的一切责任，由本人 / 单位自行承担，与贵公司无关。</p>	<p>本人 / 单位作为符合法律法规及中国证券监督管理委员会规定的集合资产管理计划合格投资者（即个人投资者具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元人民币，法人单位投资者最近一年末净资产不低于 1000 万元人民币，或为监管机构认可的其他合格投资者），具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源符合法律、行政法规的规定，资金用途合法，符合有关反洗钱法律、法规的要求。</p> <p>适用于个人投资者：</p> <p>本人所投资金为个人自有资金，没有用筹集的他人资金参与集合资产管理计划，没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资。</p> <p>如本人为管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方，将在提交参与申请时将上述情况告知管理人及销售机构。</p> <p>适用于机构投资者：</p>

特此承诺。

本单位所投资金为自有资金，没有以资产管理产品或其他合法形式筹集资金投资集合资产管理计划，没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资。

如本单位为管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方，将在提交参与申请时将上述情况告知管理人及销售机构。

贵公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及其合法性、个人及家庭金融资产、负债等情况进行调查，本人/本单位愿意配合。

本人/本单位承诺，不会拆分集合资产管理计划份额或转让份额收（受）益权。

本人/本单位满足中国证券监督管理委员会关于投资者适当性管理的规定。贵公司根据法律法规、行业自律规则的各项要求对本人/本单位进行适当性评估，本人/本单位有义务提供真实、完整、有效的证明材料，通过贵公司评估后方购买相关产品。贵公司的评价结果不构成对本人/本单位的投资建议，不构成对本人/本单位的获利保证。本人/本单位不得以不符合适当性标准为由拒绝承担交易结果。

本人/本单位在参与贵公司发起设立的集合资产管理计划的投资过程中将严格遵守上述承诺，并确保上述承诺在投资集合资产管理计划的期间持

	<p>续有效，如本人/本单位违反上述承诺，贵公司有权根据法律法规、行业自律规则做出相关处理，本人/本单位将予以配合并承担相关后果和损失，因本人/本单位违反上述承诺所产生的一切责任和损失，由本人/本单位自行承担，与贵公司无关，如贵司为此遭受经济损失的，本人/本单位将向贵司予以赔偿。</p> <p>特此承诺。</p>
<p>一、前言</p>	
<p>为规范中金指数增强2期集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作，明确《中金指数增强2期集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《管理办法》、《细则》、《中金指数增强2期集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>委托人承诺以真实身份参与集合</p>	<p>为规范中金指数增强2期(中证500)集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作，明确《中金指数增强2期(中证500)集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国电子签名法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《管理规定》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会、中国银行业协会等相关自律组织的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《管理办</p>

计划，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整，没有非法汇集他人资金参与本集合计划，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

法》、《管理规定》、《中金指数增强 2 期（中证 500）集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人应承担尽职调查等反洗钱工作职责，包括但不限于建立合理有效的反洗钱控制措施，对其自身客户开展反洗钱尽职调查等管控工作，确保所管理的资金来源合法，资金管理及投资使用不涉及恐怖融资或其他违法犯罪活动，不涉及被联合国、美国、欧盟、英国、中国公安部等制裁规则制裁的人员或行为等。管理人应建立健全客户尽职调查等反洗钱内部控制机制，在代销机构提供的客户资料范围内与托管人共享本业务项下客户尽职调查及其他相关情况。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全（在本合同、托管协议项下，“安全”不具有托管人保证委托资产不受损失或者取得最低收益的含义。对本合同、托管协议及其附件或者补充协议中其他相关约定的理解均以此为准）保管客户集合计划资

	产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。托管人不承担本集合计划的投资风险，对处于托管人实际控制之外的财产不承担托管责任，托管人不负责对托管财产所投资事项进行尽职调查。
二、释义	
《管理办法》 指《证券公司客户资产管理业务管理办法》	《管理办法》 指《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》  《管理规定》 指《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》
《细则》 指《证券公司集合资产管理业务实施细则》	《指导意见》 指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布并于 2018 年 4 月 27 日施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》
《电子签名约定书》 电子签名合同 .....	《电子签名约定书》 电子签名合同 .....
	法律法规 指中国现时有效的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
《集合计划说明书》或《说明书》 指《中金指数增强 2 期集合资产管理计	《集合计划说明书》或《说明书》 指《中金指数增强 2 期（中证 500）集

划说明书》及对其的任何修订和补充	合资产管理计划说明书》
委托人 .....	委托人 .....  份额持有人  指签署本合同，交付认购、参与资金并取得集合计划份额的投资者
退出  指在存续期内集合资产管理计划委托人根据集合资产管理计划销售网点规定的手续，向集合资产管理计划管理人卖出集合资产管理计划份额的行为  .....  银河金汇量化2号结构化计划建仓期或建仓期  指自银河金汇量化2号结构化计划成立日（含）起的十个工作日	退出  指在存续期内集合资产管理计划委托人根据集合资产管理计划销售网点规定的手续，向集合资产管理计划管理人卖出集合资产管理计划份额的行为
标的指数  指银河金汇量化2号结构化计划所采用的中证指数有限公司编制并发布的中证500指数或银河金汇量化2号结构化计划管理人根据银河金汇量化2号结构化计划相关合同约定更换的其他指数。	标的指数  指中证指数有限公司编制并发布的中证500指数。
三、集合资产管理合同当事人	
管理人  法定代表人：丁学东	管理人  法定代表人（代）： 毕明建
托管人  通信地址：北京市东城区朝阳门内大街	托管人  通信地址：北京市东城区朝阳门内大街

2号	2号凯恒中心
四、集合资产管理计划的基本情况	
<p>(一) 中金指数增强 2 期集合资产管理计划</p> <p>(二) 类型: 集合资产管理计划</p> <p>(三) 目标规模</p> <p>.....</p> <p>(四) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额;</p> <p>(2) 银行存款 (包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、不超过 7 天的债券逆回购、货币市场基金、到期日在一年以内的政府债券等现金类金融产品。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额占集合计划资产净值的比例为: 0-100%;</p> <p>(2) 银行存款、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在一年以内的政府债券占集合计划资产净值的比例为: 0-100%。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券、承销期内承销的证券、或上述主体发行、管理或提供投资顾问服务的其他金融产品, 或从事其他重大关联交易。交易完成 10 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知委托人, 并根据监管规定向相关自律组织备案, 同时抄送监管机构。</p> <p>委托人在此确认, 其知晓银河金汇量化 2 号结构化计划将主要通过投资于本管理人所管理的证券公司集合资产管理计划以及现金类金融产品实现其投资目标、投资理念和投资策略, 而且银河金汇量化 2 号结构化计划管理人同意并授权本管理人可以依据所管理的证券公司集合资产管理计划的集合合</p>	<p>(一) 中金指数增强 2 期 (中证 500) 集合资产管理计划</p> <p>(二) 类型: 权益类集合资产管理计划</p> <p>(三) 运作方式: 开放式</p> <p>(四) 目标规模</p> <p>..... (五) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围与比例</p> <p>(1) 股票、股票型基金、混合型基金、交易型开放式指数证券投资基金等权益类资产占集合计划资产净值的比例为 80% (含) -100%;</p> <p>(2) 股指期货: 在交易日终, 持有的权益类资产市值+买入股指期货合约价值-卖出股指期货合约价值的总额不得超过集合计划资产净值的 100%;</p> <p>(3) 现金、银行存款 (包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、期限在 7 天以内 (含 7 天) 的债券逆回购、货币市场基金、到期日在一年以内的政府债券等现金类金融产品占集合计划资产净值的比例为: 0-100%。</p> <p>(4) 不得投资于上市公司定向增发, 不得投资除公募基金外的资产管理产品, 不得投资任何非标资产。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关关联方关系的公司发行的证券、承销期内承销的证券, 或从事其他重大关联交易。交易完成合理期间内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知委托人, 并根据监管规定向相关自律组织备案, 同时抄送监管机构。若因托管人未向管理人提供关联方名单、导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易, 无法履行关联交易相关流程并向份额持有人、托管人披露的, 管理人不承担责任。</p> <p>如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资</p>

同约定的投资范围、投资策略等将该集合计划的资产投资于本管理人及与本管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他关联交易。委托人签署本合同即视为知悉和认可上述交易安排，并自愿承担因银河金汇量化2号结构化计划投资于本管理人所管理的证券公司集合资产管理计划而产生的相关风险和损失。

如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人在履行合同变更程序后，可以变更集合计划投资范围或者投资比例。

#### （五）管理期限

本集合计划无固定存续期，管理人有权根据本合同的约定决定终止本集合计划。

#### （六）封闭期、开放期及流动性安排

1、封闭期：除开放日及管理人设置的特殊开放期外，本集合计划存续期内封闭管理，不办理参与、退出业务。

2、开放日：本集合计划自集合计划成立日起满3个月后的次月起（含）每月第二周周五为开放日，如遇节假日则顺延至节假日后第一个工作日。开放日可

的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人在履行合同变更程序后，可以变更集合计划投资范围或者投资比例。

委托人在此同意并授权，本集合计划存续期间，为规避特定风险，管理人投资于权益类资产的比例可以低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于80%。

委托人知悉并同意，托管人仅在每个估值日后对以下条款进行事后监督：

（1）股票、股票型基金、混合型基金、交易型开放式指数证券投资基金等权益类资产占集合计划资产净值的比例为80%（含）-100%；

（2）股指期货：在交易日终，持有的权益类资产市值+买入股指期货合约价值-卖出股指期货合约价值的总额不得超过集合计划资产净值的100%；

（3）现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、期限在7天以内（含7天）的债券逆回购、货币市场基金、到期日在一年以内的政府债券等现金类金融产品占集合计划资产净值的比例为：0-100%。

（4）不得投资于上市公司定向增发，不得投资除公募基金外的资产管理产品，不得投资任何非标资产。

#### （六）管理期限

本集合计划存续期限为10年，出现集合资产管理合同约定的终止情形时，终止清算。

#### （七）封闭期、开放期及流动性安排

1、封闭期：除开放日外，本集合计划存续期内封闭管理，不办理参与、退出业务。

2、开放日：本集合计划自集合计划成立日起满3个月后的次月起（含）每月第二周周五为开放日，如遇节假日则顺延至节假日后第一个工作日。开放日可办理集合计划份额的参与和退出业务。

3、流动性安排：在开放日保持适当比

办理集合计划份额的参与和退出业务。  
3、流动性安排：在开放日保持适当比例的现金、到期日在一年以内的政府债券或者其他高流动性短期金融工具。

.....

(十) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划所投资的标的为跟踪指数型产品，属高风险产品，适合具有较高风险承受能力且法律法规允许的合格个人投资者和合格机构投资者。

(十一) 本集合计划的推广

.....

## 2、推广方式

管理人应将《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》等正式推广文件，以纸质资料方式置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决策。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传和商业贿赂等不正当手段推广集合计划，禁止向投资者宣传资产管理计划预期收益率。

(十二) 本集合计划的各项费用

1、参与费：本集合计划对参与设置级差费率，参与费率随参与金额的增加而递减。

参与金额 (M)	参与费率
M≤300 万	1.0%
300 万 < M < 1000 万	0.8%
1000 万 ≤ M	0.5%

参与费用由委托人承担，不列入集合计划资产。

.....

3、管理费：本集合计划无管理费。

4、托管费：本集合计划无托管费。

.....

6、其他费用：除交易手续费、印花税、电子合同业务服务费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相

例的现金、到期日在一年以内的政府债券或者其他高流动性短期金融工具。管理人主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。

.....

(十一) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划管理人评定的风险等级为【中风险 R3】，适合风险承受能力为【激进型 (C5)、积极型 (C4)、稳健型 (C3)】的投资者。

(十二) 本集合计划的推广

.....

## 2、推广方式

管理人应将《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》等正式推广文件，以纸质资料方式置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决策。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

(十三) 本集合计划的各项费用

1、参与费：本集合计划参与费率为 1.0%。参与费用由委托人承担，不列入集合计划资产。

.....

3、管理费：按集合计划资产净值的 0.5% 的年费率计收。

4、托管费：按集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计收。

.....

6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、托管费、电子合同业务服务费

<p>应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入费用，从集合计划资产中支付。</p> <p>(十三)银河金汇量化2号结构化集合资产管理计划基本情况</p> <p>.....</p>	<p>之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入费用，从集合计划资产中支付。</p>
---	---

**五、 集合计划的参与和退出**

<p>(一) 集合计划的参与</p> <p>1、参与的办理时间</p> <p>.....</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>投资者在集合计划开放日可以办理参与本集合计划的业务。本集合计划开放日为自集合计划成立日起满3个月后的次月起(含)每月第二周周五，如遇节假日则顺延至节假日后第一个工作日。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。</p> <p>.....</p> <p>2、参与的原则</p> <p>.....</p> <p>(6) 管理人和推广机构有权视投资者</p>	<p>(一) 集合计划的参与</p> <p>1、参与的办理时间</p> <p>.....</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>投资者在集合计划开放日可以办理参与本集合计划的业务。本集合计划开放日为自集合计划成立日起满3个月后的次月起(含)每月第二周周五，如遇节假日则顺延至节假日后第一个工作日。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、监管机构、自律组织要求或本合同约定暂停参与的除外。若出现证券交易所等交易场所变更交易时间、或者发生影响本集合计划正常运作的重大事项的，管理人有权视情况对参与业务具体办理时间进行相应的调整。委托人在此同意管理人保留对本集合计划的规模合理控制的权利，在本集合计划达到一定规模后，管理人可向委托人公告后在开放日暂不接受参与，之后管理人可视情况向委托人公告后恢复参与。</p> <p>.....</p> <p>2、参与的原则</p> <p>.....</p> <p>(6) 管理人和推广机构有权视投资者的投资经验、风险承受能力、资金来源及用途等，决定是否接受投资者的参与</p>
--	---

的投资经验、风险承受能力、资金来源及用途等，决定是否接受投资者的参与申请，并保留拒绝任何投资者参与本集合计划申请的权利。

申请，并保留拒绝任何投资者参与本集合计划申请的权利。

(7) 如管理人对某一开放日(T日)内委托人提出的参与、退出申请进行确认后导致本集合计划的投资者少于两人，管理人有权决定不予确认委托人于T日及之后提出的参与、退出申请，并终止本集合计划。在上述情况下，如管理人决定提前终止本集合计划的，本集合计划于【T+1】日提前终止，进入清算程序。对委托人于T日及之后提出的参与、退出申请，管理人将不予确认；但对在T日前提出的参与、退出申请，管理人将按照本合同约定的参与、退出程序正常处理。

(8) 如管理人对某一开放日(T日)内份额持有人提出的参与、退出申请进行确认后导致本集合计划资产净值低于【1000】万元时，管理人有权决定不予确认份额持有人于T日及之后提出的所有参与、退出申请，并终止本集合计划。在上述情况下，如管理人决定提前终止本集合计划的，本集合计划于【T+1】日提前终止，进入清算程序。对份额持有人于T日及之后提出的参与、退出申请，管理人将不予确认；但对在T日前提出的参与、退出申请，管理人将按照本合同约定的参与、退出程序正常处理。

(9) 当接受参与申请对存量集合计划委托人利益构成潜在重大不利影响时，管理人可以采取设定单一投资者参与金额上限或集合计划单日净参与比例上限、拒绝大额参与、暂停参与等措施，具体规定请参见相关公告。

(10) 管理人可在法律法规允许的情况下，设定或调整单一投资者参与金额和持有份额的数量限制。管理人应在调整实施前在管理人网站公告投资者。

管理人可在法律法规允许的范围内，根据本集合计划运作的实际情况对上述原则进行调整，并于新的参与、退出原则开始实施前在管理人网站公告投资者。

.....

#### 4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：本集合计划对参与设置级差费率，参与费率随参与金额的增加而递减。

参与金额(M)	参与费率
M≤300万	1.0%

300 万 < M < 1000 万	0.8%
1000 万 ≤ M	0.5%

参与费用由委托人承担，不列入集合计划资产。

(2) 参与份额的计算方法:

.....

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

.....

6、拒绝或暂停参与的情形及处理

.....

(6) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时;

(7) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人利益的情形;

(8) 如银河金汇量化 2 号结构化计划管理人根据其集合合同暂停其份额参与，本集合计划管理人有权暂停接受本集合计划份额参与;

(9) 法律、法规规定、中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

.....

4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率: 本集合计划参与费率为 1.0%。参与费用由委托人承担，不列入集合计划资产。

(2) 参与份额的计算方法:

.....

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

当发生大额参与情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

.....

6、拒绝或暂停参与的情形及处理

.....

(6) 当前一估值日占本集合计划资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时;

(7) 管理人接受某笔或者某些参与申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度限制的情形时;

(8) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时;

(9) 当投资者不符合《管理办法》、《运作规定》或其他法律法规及本合同、《计划说明书》关于合格投资者的规定，违反反洗钱、制裁及打击恐怖融资、反贪污贿赂及其他金融犯罪等相关法律法规，或管理人审核后认为不适合接受投资者参与申请的其他情形的;

(10) 根据市场情况，管理人无法找到

<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间 .....构成本合同的有效组成部分。     委托人在此同意管理人有权在出现本合同第五条第(二)部分第10点约定的情形时强制退出部分份额。</p> <p>2、退出的原则 .....     (4) 委托人单笔退出(含强制退出)无最低份额限制;     (5) 管理人有权根据《集合资产管理合同》约定, 办理集合计划份额的强制退出手续。</p> <p>3、退出的程序和确认     (1) 退出申请的提出         委托人须根据推广机构规定的手续, 在集合计划开放日的交易时间段内向推广机构提出本集合计划退出申请。         强制退出无需委托人提出退出的申请, 由管理人主动发起。</p> <p>    (2) 退出申请的确认         推广机构在集合计划开放日规定时间受理的委托人退出申请, 正常情况下注册登记机构在 T+2 日内对该申请的有效性进行确认, 并为委托人登记权益并办理注册与过户登记手续。委托人在 T+3 日后可向推广机构查询退出的成交情况, 若遇到法定节假日顺延。管理人在 T 日发起强制退出申请的, 委托人在 T+3 日后可向集合计划推广机构查询强制退出的成交情况, 若遇到法定节假日顺延。若交易未成功或数据不符, 委托人可与为其办理手续的人员联</p>	<p>合适的投资品种, 或其他可能对本集合计划业绩产生负面影响, 从而损害现有委托人利益的情形;     (11) 管理人、托管人、销售机构或份额登记机构的技术故障等异常情况导致销售系统、注册登记系统或会计系统无法正常运行;     (12) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响, 从而损害现有委托人利益的情形;     (13) 法律、法规规定、中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p> <p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间 .....构成本合同的有效组成部分。</p> <p>2、退出的原则 .....     (4) 委托人单笔退出无最低份额限制;</p> <p>3、退出的程序和确认     (1) 退出申请的提出         委托人须根据推广机构规定的手续, 在集合计划开放日的交易时间段内向推广机构提出本集合计划退出申请。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间, 但管理人根据法律法规、监管机构、自律组织要求或本合同约定暂停退出的除外。若出现证券交易所等交易场所变更交易时间、或者发生影响本集合计划正常运作的重大事项的, 管理人有权视情况对退出业务具体办理时间进行相应的调整。</p> <p>    (2) 退出申请的确认         推广机构在集合计划开放日规定时间受理的委托人退出申请, 正常情况</p>
---	---

系并进行核实。大额退出和巨额退出的情形按本合同约定办理。

### (3) 退出款项划付

委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定资金账户，退出款项的划拨自退出申请确认后5个工作日内完成。管理人在T日发起强制退出申请的，相应退出款将于T+5个工作日内划往退出委托人指定的账户。如集合计划出现暂停估值的情形或由于非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。发生大额退出和巨额退出的情形按本合同约定办理。

## 4、退出费及退出金额的计算

### (2) 退出金额的计算方法

委托人在退出本集合计划时缴纳退出费用，委托人的退出净额为退出金额扣减退出费用后的余额。退出净额的计算结果按照四舍五入方法保留小数点后两位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差归入集合计划资产。

退出净额的计算方式如下：

退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值

退出费用 = 退出金额 × 退出费率

退出净额 = 退出金额 - 退出费用

.....

## 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

### (1) 单个委托人大额退出的认定

单个委托人单日退出份额达到或超过500万份（含500万份），即视为单个委托人大额退出。单个委托人在单个开放日强制退出份额达到或超过500万

份，下注册登记机构在T+1日内对该申请的有效性进行确认，并为委托人登记权益并办理注册与过户登记手续。委托人在T+2日后可向推广机构查询退出的成交情况，若遇到法定节假日顺延。若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的人员联系并进行核实。大额退出和巨额退出的情形按本合同约定办理。

### (3) 退出款项划付

委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定资金账户，退出款项的划拨自退出申请确认后5个工作日内完成。如集合计划出现暂停估值的情形或由于非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。发生大额退出和巨额退出的情形按本合同约定办理。

委托人指定资金账户应为委托人支付认购、参与款项的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户。管理人和销售机构有权要求委托人就其指定资金账户出具符合相关法律法规规定的书面说明，否则管理人和销售机构均有权暂缓退出款项的划付，由此造成任何后果，由委托人自行承担。

## 4、退出费及退出金额的计算

### (2) 退出金额的计算方法

退出金额的计算结果按照四舍五入方法保留小数点后两位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差归入集合计划资产。

退出金额的计算方式如下：

退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值

当发生大额退出情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划

份时，不属于大额退出。

## (2) 单个委托人大额退出的申请和 处理方式

单个委托人大额退出需委托人在退出  
日的前2个工作日向推广机构提出预约  
申请，否则管理人和推广机构有权拒绝  
其退出申请。

## 7、巨额退出的认定和处理方式

### (1) 巨额退出的认定

本集合计划单个开放日，委托人当  
日累计净退出申请的集合计划单位份  
额数（退出申请份额总数扣除申购申  
请份额总数的余额）超过上一日集合  
计划总份额的8%时，即认为发生了巨  
额退出。连续巨额退出是指连续两个  
开放日或以上，集合计划净退出申  
请份额超过上一日集合计划总份额的  
8%。

单个开放日，强制退出总份额扣除  
参与申请总份额之余额超过上一工作  
日集合计划总份额的8%时，不属于巨  
额退出。

.....

3) 暂停退出：连续两个或以上开放日  
发生巨额退出的，管理人可以暂停接  
受退出申请；已经接受的退出申请可  
以延缓支付退出款项。因暂停退出或  
延缓支付导致的损失由委托人自行承  
担。暂停和延缓期限不得超过3个月。

## 8、拒绝或暂停退出的情形及处理

.....

(3) 证券交易场所、中国金融期货交  
易所或银行间债券市场交易时间非正  
常停市，导致当日集合计划资产净值  
无法计算；

(4) 银河金汇量化2号结构化计划暂  
停估值；

(5) 银河金汇量化2号结构化计划暂  
停退出；

估值的公平性，具体处理原则与操作规  
范遵循相关法律法规以及监管部门、自  
律规则的规定。

.....

## 6、单个委托人大额退出的认定、申 请和 处理方式

### (1) 单个委托人大额退出的认定

单个委托人单日退出份额达到或超过  
500万份（含500万份），即视为单  
个委托人大额退出。

### (2) 单个委托人大额退出的申 请和 处理方式

单个委托人大额退出需委托人在退出  
日的前2个工作日向推广机构提出预  
约申请，否则管理人和推广机构有权  
拒绝其退出申请。如管理人认为接受  
该单个委托人大额退出申请对存量委  
托人利益构成潜在重大不利影响，管  
理人有权拒绝其退出申请或仅接受其  
部分退出申请。

## 7、巨额退出的认定和处理方式

### (1) 巨额退出的认定

本集合计划单个开放日，委托人当  
日累计净退出申请的集合计划单位份  
额数（退出申请份额总数扣除申购申  
请份额总数的余额）超过上一日集合  
计划总份额的8%时，即认为发生了巨  
额退出。连续巨额退出是指连续两个  
开放日或以上，集合计划净退出申  
请份额超过上一日集合计划总份额的  
8%。

.....

3) 暂停退出：连续两个或以上开放日  
发生巨额退出的，管理人可以暂停接  
受退出申请；已经接受的退出申请可  
以延缓支付退出款项。因暂停退出或  
延缓支付导致的损失由委托人自行承  
担。暂停和延缓期限不得超过3个月，  
如因占投资组合较大比例的投资品种  
处于封闭期、锁定期、限售期、停  
牌、涨停板、缺乏市场流动性、付款  
义务人违约、按照相关资产投资文件  
的约定无法转让/赎回/退出/提前终  
止/提取等非管理人原因延期除外。

(6) 银河金汇量化 2 号结构化计划发生巨额退出并部分顺延退出的;

(7) 法律法规规定或中国证监会等有权机关认定的其它情形。

发生上述情形之一的,已接受的退出申请,集合计划管理人将足额支付;如暂时不能支付的,可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付,但最长不超过正常支付时间的 6 个月,并报告给委托人。

发生拒绝或暂停受理退出的情形时,管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时,管理人应及时恢复退出业务的办理。

#### 9、银河金汇量化 2 号结构化计划发生合同变更时的退出机制

如果银河金汇量化 2 号结构化计划发生合同变更导致本合同需要变更,则根据本合同约定的合同变更程序办理。如果银河金汇量化 2 号结构化计划发生合同变更不会导致本合同需要进行合同变更,但管理人认为对本计划委托人利益有重大影响时,本集合计划管理人有权在信息披露相关变化的同时,设立特殊开放期,允许委托人在特殊开放期选择退出本集合计划,具体方案以管理人公告为准。

#### 10、银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额发生强制退出时本集合计划份额的强制退出机制

委托人确认并同意,在银河金汇量化 2 号结构化计划管理人强制退出本集合计划参与的银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额时,本集合计划管理人有权设置特殊开放期,以本集合计划实际收到的银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额退出款项为限,按照单个委托人持有的份额占本集合计划总份额的比例强制退出本集合计划的部分份额,具

.....

#### 8、拒绝或暂停退出的情形及处理

.....

(3) 证券交易场所、中国金融期货交易所或银行间债券市场交易时间非正常停市,导致当日集合计划资产净值无法计算;

(4) 当前一估值日占本集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时;

(5) 占投资组合较大比例的投资品种处于封闭期、锁定期、限售期、停牌、涨停板、市场流动性受限、付款义务人违约或其他非管理人原因造成集合计划资产无法正常变现;

(6) 接受退出申请将导致集合计划的负债比例(即总资产/净资产)超过法律法规、监管规定或本计划约定的负债比例上限的(包括但不限于将导致本计划的债券正回购资金余额或逆回购资金余额/本计划上一日净资产超过法律法规、监管规定或本计划约定的比例上限的);

(7) 管理人、托管人、销售机构或注册登记机构的技术故障等异常情况导致销售系统、注册登记系统或会计系统无法正常运行;

(8) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时;或(9) 法律法规规定或中国证监会等有权机关认定的其它情形。

发生上述情形之一的,已接受的退出申请,集合计划管理人将足额支付;如暂时不能支付的,可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付,但最长不超过正常支付时间的 6 个月,并报告给委托人。大额退出、巨额退出及连续巨额退出另有约定的,从其约定。

发生拒绝或暂停受理退出的情形

<p>体方案以管理人公告为准。</p>	<p>时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p>
<p>十、集合计划的账户与资产</p>	
<p>(一) 集合计划账户的开立</p> <p>托管人为本集合计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。具体托管账户、资金账户名称和证券账户名称以实际开立情况为准。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 集合计划账户的开立</p> <p>托管人为本集合计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“中金指数增强 2 期集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“中金公司 - 中国银行 - 中金指数增强 2 期集合资产管理计划”。(具体资金账户名称和证券账户名称以实际开立情况为准)。</p> <p>.....</p>
<p>十二、集合计划的估值</p>	
<p>(七)估值方法: 集合计划资产的估值, 参照《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及《集合资产管理合同》中约定的估值方法进行。</p> <p>1、在证券交易所市场流通的债券, 按如下估值方式处理:</p> <p>    实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值。</p> <p>    未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。</p> <p>2、银行存款以成本列示, 按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>3、货币市场基金按成本估值, 每日按公布的估值日万份收益率计提收益。</p>	<p>(七)估值方法: 集合计划资产的估值, 参照《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及《集合资产管理合同》中约定的估值方法进行。</p> <p>1、上市流通的股票, 以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值; 估值日无交易的, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 以最近交易日的市价(收盘价)估值;</p> <p>2、封闭式基金按照其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值; 场内交易的交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 按照其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值; 托管在场外的交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 按照估值日前一日交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 单位净值估值; 估值日前</p>

4、集合资产管理计划以估值日当日产品单位份额净值估值，该日无交易的，以最近一日单位份额净值计算。

5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。

6、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时、集合计划所投资的金融产品暂停估值或估值错误、或因不可抗力或其他非管理人能控制的情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

一交易日基金单位净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值计算；LOF、ETF 在场内的，以估值日该证券收盘价估值；该日无交易的，以最近一日收盘价计算；

3、未上市的股票按以下情况分别处理：配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；首次公开发行的股票，按成本价估值；

4、开放式证券投资基金以估值日前一日开放式基金单位净值估值。估值日无交易的，按最近交易日基金单位净值估值。

5、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

6、期货合约以期货交易所当日公布的结算价确定公允价值，当日未公布的，以最近一日的结算价计算；

7、货币市场基金按成本估值，每日按公布的前一日万份收益率计提收益；

8、银行存款和债券回购以成本估值并按其商定利率在持有期内逐日计提应收利息。

9、如有确凿证据表明按前述办法进行估值不能客观反映其公允价值，本集合计划的管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上，在与托管人商定之后，按最能反映公允价值的价格估值；

10、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

11、暂停估值的情形：

1) 集合计划投资所涉及的证券期货交易所等交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；

2) 占投资组合较大比例的投资品种暂停估值或估值出现错误或重大问题，致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值；

3) 因不可抗力或其他非管理人能控制的情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值；

4) 当前一估值日占本集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活

<p>(八) 估值程序: 日常估值由管理人与托管人同时进行。T+1 日取得底层资产最新估值价格后管理人与托管人对于 T 日结果进行核对。用于披露的资产净值由管理人完成估值后, 将估值结果报送托管人, 托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核; 托管人复核无误后返回给管理人。</p> <p>.....</p> <p>(十) 估值复核: 管理人应将估值日的资产净值结果以传真方式发送给托管人, 或以管理人、托管人协商一致的其他方式进行资产净值核对。托管人在当日经复核无误后, 盖章并以传真方式将复核结果传送给管理人。</p>	<p>跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性并经与托管人协商确认后暂停估值; 或</p> <p>5) 法律法规、中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p> <p>估值条件恢复时, 集合计划管理人必须按规定完成估值工作。</p> <p>(八) 估值程序: 日常估值由管理人与托管人同时进行。T 日管理人与托管人对于 T 日结果进行核对。用于披露的资产净值由管理人完成估值后, 将估值结果报送托管人, 托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核; 托管人复核无误后返回给管理人。</p> <p>.....</p> <p>(十) 估值复核: 管理人应将估值日的资产净值结果以传真方式发送给托管人, 或以管理人、托管人协商一致的其他方式进行资产净值核对。托管人在当日经复核无误后, 以双方认可的方式将复核结果反馈给管理人。</p>
---	--

十三、集合计划的费用、业绩报酬

<p>(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费: 本集合计划无托管费。</p>	<p>(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费:          托管费按集合计划资产前一日资产净值的【0.05】%的年费率计提。计算方法如下:  <math>H = E \times 0.05\% \div \text{当年实际天数}</math>          H 为每日应计提的托管费, E 为前一日集合计划资产净值。          集合计划托管费每日计提, 逐日累计至每自然季度季末, 按季支付。经管理人授权, 由集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后, 自动在下一个自然季度开始后五个工作日内进行资金支付, 管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后, 管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系托管人协商解决, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。</p>
---	--

2、管理费：本集合计划无管理费。

3、证券交易费用：

集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。

5、其他费用：

.....

(2) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

.....

(四) 集合计划的税收：本集合计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

托管费收款账户信息如下：

户名：券商资管计划托管费收入

账号：9022435681001

开户银行：中国银行北京市分行金融机构部

指令备注写明：支付托管费

2、管理费：

管理人按集合计划资产前一日净值的【0.5】%年费率收取集合计划管理费。计算方法如下：

$H = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$

H为每日应计提的管理费，E为前一日资产净值。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每自然季度季末，按季支付。经管理人授权，由集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，自动在下一个自然季度开始后五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理费收取账户信息如下：

账户名：中国国际金融股份有限公司

账号：11001085100056000400

开户行：中国建设银行北京市国贸支行  
大额支付系统号：105100010123

3、证券交易费用：

集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、管理费、托管费、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。

.....

5、其他费用：

.....

(2) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

(3) 注册登记机构收取的相关费用。

.....

(四) 集合计划的税收：本集合计划运

	<p>作过程中, 各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。根据相关法律法规的要求, 自 2018 年 1 月 1 日或税务主管机关确定的其他日期起, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。本集合计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费由本集合计划财产承担, 托管人应在管理人指定时间内, 将应缴税款划转至管理人指定账户, 由管理人依据税务部门要求完成税款的申报缴纳。如果管理人以固有财产先行垫付上述增值税等税费的, 管理人有权优先从集合计划财产中划扣抵偿。本集合计划清算后若管理人被税务机关要求补缴应由集合计划财产承担的上述税费的, 则管理人有权向份额持有人就补缴金额进行追偿。</p>
<h4>十四、集合计划的收益分配</h4>	
<p>(一) 收益构成</p> <p>集合计划收益分配是指按规定将集合计划的可分配收益按集合计划单位进行比例分配。</p> <p>集合计划的收益包括: 集合计划投资所得红利债券利息、银行存款利息、本集合计划参与的银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额依据该计划集合资产管理合同约定所获得的份额收益及其他合法收入。</p>	<p>(一) 收益构成</p> <p>集合计划收益分配是指按规定将集合计划的可分配收益按集合计划单位进行比例分配。</p> <p>集合计划的收益包括: 集合计划投资所得红利债券利息、银行存款利息、及其他合法收入。</p>
<h4>十五、投资理念与投资策略</h4>	
<p>(二) 投资策略</p> <p>本集合计划主要通过参与银河金汇量化 2 号结构化计划 A 类份额来实现预期的投资目标。该 A 类份额为指数增强型份额, 具有指数型产品的高风险高收益特征。</p> <p>银河金汇量化 2 号结构化计划的投资策略详见本合同第四条。</p>	<p>(二) 投资策略</p> <p>指数增强策略采用中金量化团队的多因子选股模型, 构建行业因子库和风格因子库, 包括, 价值因子、动量因子、交易活动因子、波动性因子、规模因子等; 结合因子的经济意义, 投资者交易行为等, 分析因子的历史表现, 自上而下的确定因子组合; 在实际的运行中, 及时监控各类因子收益率的变动, 动态调整因子组合。</p>

十六、投资决策与风险控制	
<p>(三) 风险控制</p> <p>风险管理委员会是中金公司资产管理部管理层领导下的,对部门整体风险进行管理和控制的专业委员会,负责对部门运作管理中的各类风险进行识别、评估和控制,并定期向资产管理部管理层报告。委员会按照独立性、全面性和客观性的原则开展本集合计划风险评估与管理工作。</p>	<p>(三) 风险控制</p> <p>管理人建立了由部门风险管理委员会、投资决策委员会、风控组、投研组、交易组和相关业务组共同构成的顺序递进、权责统一、严密有效的多层次风险管理体系,以贯彻投资风险管理理念。风险控制措施流程包括投资前、投资中、投资后三部分,着重在事前风险控制。其中投资前风险控制主要是投研人员基于基本面研究方面的主观评估,投资中风险控制主要是对交易执行、合规运作等方面的审批监控,投资后风险控制主要是基于组合绩效和风险分析方面的量化评估。</p>
十七、投资限制及禁止行为	
<p>(一) 投资限制</p> <p>1、中国证监会规定的限制行为; 2、本集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行适当程序后,本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>	<p>(一) 投资限制</p> <p>1、投资于单一基金的投资额不得超过前一日资管计划净值的20% (以成本价计算,货币基金除外)。</p> <p>2、按买入成本计算,持有一家公司发行的股票不得超过资管计划净值的5%,投资于一家上市公司所发行的股票,不得超过该上市公司总股本的4.99%,同时不得超过该上市公司流通股本的10%。</p> <p>3、按买入成本计算,投资创业板股票总金额不得超过资管计划净值的30%。</p> <p>4、本系列资管计划不得购买s、sst、s*st、st、*st类股票,不得投资于上市公司定向增发,不得开展融资融券业务,不得投资商品期货,不得投资其他信托或资管计划、非保本银行理财产品,不得投资任何非标资产,不得投资分级基金劣后级。中国证监会规定的限制行为。</p> <p>5、本集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>

	<p>因证券市场波动、公司合并、资管计划规模变动等因素致使资管计划投资不符合本资管计划约定的投资限制的，管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，遇股票停牌等限制流通的情况，调整时间顺延。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>
--	---

## 十八、集合计划的信息披露

<p><b>(一) 定期报告</b></p> <p><b>1、集合计划单位净值报告</b></p> <p>本集合计划成立后，封闭期内，每周第二个工作日披露上周最后一个工作日的单位净值、累计净值。开放日(T日)的单位净值、累计净值在 T+2 日披露。</p> <p>.....</p> <p><b>2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告</b></p> <p>.....</p> <p>本集合计划成立不足 2 个月时，可以不编制当期的季度报告。上述报告应于每季度截止日后 15 日内（不含法定节假日）通过管理人网站通告。季度报告应按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p><b>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</b></p> <p>.....</p> <p>本集合计划成立不足 3 个月时，可以不编制当期的年度报告。上述报告应在每年度结束之日起 3 个月内通过管理人网站公告。年度报告应按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p>.....</p> <p><b>4、审计报告</b></p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行审计，并在每年度结束之日起 3 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供，并</p>	<p><b>(一) 定期报告</b></p> <p><b>1、集合计划单位净值报告</b></p> <p>本集合计划成立后，封闭期内，每周第一个工作日披露上周最后一个工作日的单位净值、累计净值。开放日(T日)的单位净值、累计净值在 T+1 日披露。</p> <p>.....</p> <p><b>2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告</b></p> <p>.....</p> <p>本集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月时，可以不编制当期的季度报告。上述报告应于每季度截止日后 1 个月内（不含法定节假日）通过管理人网站通告。季度报告应按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p><b>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</b></p> <p>.....</p> <p>本集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月时，可以不编制当期的年度报告。上述报告应在每年度结束之日起 4 个月内通过管理人网站公告。年度报告应按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p><b>4、审计报告</b></p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行审计，并在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供，并</p>
--	---

<p>按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p>.....</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或银河金汇量化2号结构化计划发生合同变更或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>.....</p> <p>(9) 集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券、承销期内承销的证券、或上述主体发行、管理或提供投资顾问服务的其他金融产品，或从事其他重大关联交易；</p> <p>(10) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(11) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(12) 其他管理人认为重大的事项。</p>	<p>按监管要求报相关自律组织备案，同时抄送监管机构。</p> <p>.....</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>.....</p> <p>(9) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(11) 其他管理人认为重大的事项。</p>
<p>二十、集合计划的展期</p>	
<p>本集合计划不设固定存续期，无展期安排。</p>	<p>本集合计划存续期为10年，在符合一定的条件下可以展期。</p> <p>(一) 展期的条件</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反本合同的约定；</li> <li>2、展期没有损害委托人利益的情形；</li> <li>3、展期符合集合资产管理计划的成立条件；</li> <li>4、中国证监会规定的其他条件。</li> </ol> <p>(二) 展期的程序与期限</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、展期的程序：本集合计划存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止，或展期继续管理本集合计划。本集合计划存续期届满拟展期时，管理人应当与</li> </ol>

托管人协商展期事宜。管理人在收到托管人同意展期的书面文件后通知委托人。

2、展期的期限：本集合计划展期的期限以展期公告中的展期期限为准。

### （三）展期的安排

#### 1、通知展期的时间

管理人拟展期的，管理人应当在收到托管人同意展期的书面文件后向委托人披露。

#### 2、通知展期的方式

展期公告将通过管理人网站或本合同约定的其他方式进行披露。如管理人对《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》有关内容进行了更新和调整，更新和调整后的《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》将同时在展期公告中及管理人办公场所进行披露。

#### 3、委托人回复的方式

同意本集合计划展期的份额持有人，在展期确认时间内（以管理人公告时间段为准），根据销售机构要求签订更新后的《集合合同》。展期确认时间内未签署更新后《集合合同》的份额持有人，则视为不参与本集合计划的展期，管理人将按照原《集合合同》的约定，对其持有的集合计划份额一次性统一办理到期退出手续。

### （四）委托人不同意展期的处理办法

管理人应对不同意展期的委托人退出事宜作出公平、合理安排。管理人应当对其持有的集合计划份额一次性统一办理到期退出手续。

### （五）展期的实现

在原存续期届满日后第1个工作日，本集合计划符合以下条件时，则本集合计划展期将于原存续期届满后第1个工作日确认展期：

- 1、同意本集合计划展期的委托人的人数不少于2人；
- 2、在原存续期届满日后第1个工作日，本集合计划参与资金总额不低于1,000万元人民币。

集合计划展期成立后5个工作日

	<p>内，管理人应当将展期情况报中国证券投资基金业协会备案，并同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
<p>二十一、集合计划终止与清算</p>	
<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、计划存续期间，客户少于 2 人；</li> <li>2、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</li> <li>3、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；</li> <li>4、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>5、托管人根据本合同第二十八条的约定单方终止托管业务合作的；</li> <li>6、法律、行政法规或中国证监会规定以及本合同约定的其他情况。</li> </ol> <p>(二) 管理人有权终止集合计划的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、当本集合计划资产净值低于 1000 万元时，管理人有权（但并非必须）终止本集合计划；</li> <li>2、当发生影响或可能影响本集合计划运作的情形（包括但不限于银河金汇量化 2 号结构化计划终止，市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见等），管理人有权视情况决定终止本集合计划。</li> </ol> <p>(三) 集合计划的清算</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、自集合计划终止之日起 5 日内（不含法定节假日）成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</li> <li>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</li> <li>3、清算方案公布后 5 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或《集合资产管理合同》的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并及时注销集合计划专用证券账户和资金账户；</li> </ol>	<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、计划存续期间，持续 5 个工作日客户少于 2 人；</li> <li>2、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</li> <li>3、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</li> <li>4、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>5、托管人根据本合同第二十八条的约定单方终止托管业务合作的；</li> <li>6、未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；</li> <li>7、法律、行政法规或中国证监会规定以及本合同约定的其他情况。</li> </ol> <p>(二) 管理人有权终止集合计划的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、本集合计划存续期间，份额持有人少于 2 人；</li> <li>2、当本集合计划资产净值低于 1000 万元时，管理人有权（但并非必须）终止本集合计划；</li> <li>3、当发生影响或可能影响本集合计划运作的情形（包括但不限于市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见或窗口指导、暂停估值或暂停参与或退出情形持续未消除等），管理人有权视情况决定终止本集合计划。</li> <li>4、本集合计划投资目的已实现或已确定无法实现的；</li> <li>5、当前一估值日占本集合计划资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，管理人决定终止的。</li> </ol> <p>(三) 管理人和托管人更换</p> <p>管理人或托管人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、</p>

<p>.....</p>	<p>宣告破产的，本集合计划终止清算。</p> <p>(四) 集合计划的清算</p> <p>1、自集合计划终止之日起5日内（不含法定节假日）成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>3、清算方案公布后5个工作日内，管理人和托管人应当在扣除管理费、托管费、清算费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或《集合资产管理合同》的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并及时注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>.....</p>
--------------	--

**二十二、当事人的权利和义务**

<p>(一) 委托人的权利和义务</p> <p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 取得集合计划收益；</p> <p>(2) 通过本合同约定的方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；</p> <p>(4) 按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；</p> <p>(5) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；</p> <p>(6) 其他权利法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。</p> <p>2、委托人的义务</p> <p>(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；</p> <p>(2) 按照本合同及《说明书》约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；</p>	<p>(一) 委托人的权利和义务</p> <p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 分享集合计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余集合计划财产；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出和转让集合计划份额；</p> <p>(4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得集合计划的信息披露资料；</p> <p>(5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(6) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、委托人的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 保证符合法律、行政法规和监管机构规定的合格投资者的相关标准，不存在法律、行政法规和监管机构规定禁止或限制参与本集合计划的情形；接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和</p>
---	--

(4) 不得违规转让其所拥有的集合计划份额;

(5) 以电子签名方式签署本合同的, 委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料; 委托人应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料, 防止他人以委托人名义实施电子签名行为;

(6) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利

(1) 根据本合同及《说明书》的约定, 独立运作集合计划的资产, 代表集合计划签署并履行相关法律文件;

(2) 根据本合同及《说明书》的约定, 收取管理费等费用;

(3) 按照本合同及《说明书》的约定, 停止办理集合计划份额的参与, 暂停办理集合计划的退出事宜;

(4) 根据本合同及《说明书》的约定, 终止本集合计划的运作;

(5) 监督托管人, 并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益;

(6) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利;

(7) 集合计划资产受到损害时, 向有关责任人追究法律责任;

(8) 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

### 2、管理人的义务

(1) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守, 履行诚实信用、谨慎勤勉的义务, 以专业技能管理集合计划的资产, 为委托人的最大利益服务, 依法保护委托人的财产权益;

(2) 进行资产估值等会计核算;

(3) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定, 接受托管人的监督;

(4) 依法对托管人、代理推广机构的

风险承受能力等基本情况, 如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况, 并对其真实性、准确性和完整性负责, 签署《投资者承诺函》及其他合格投资者相关文件; 前述信息资料如发生任何实质性变更, 应当及时书面告知管理人或其销售机构;

(3) 除公募资产管理产品外, 以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本集合计划的, 应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源;

(4) 认真阅读并签署《风险揭示书》, 主动了解所投资品种的风险收益特征; 确认有能力识别、评估并承担投资于本集合计划及其项下投资品种的各项风险, 对本集合计划投资品种的交易结构、运作市场、运作规则、相关风险以及该等风险可能引起的后果和损失有充分清晰的认知和理解;

(5) 按照本合同约定支付集合计划份额的参与款项, 承担本合同约定的管理费、业绩报酬(如有)、托管费、外包服务费(如有)、投资顾问费(如有)、审计费、税费等合理费用;

(6) 在持有的集合计划份额范围内, 承担本集合计划亏损或者终止的有限责任; 退还因管理人、托管人、销售机构差错而获得的不当得利;

(7) 以真实身份参与本集合计划, 向管理人或本集合计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件, 配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作; 按照要求签署、提交声明、告知书等相关文件; 保证其向管理人或本集合计划销售机构提供的信息和资料真实、完整、准确、合法, 不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导, 前述信息资料如发生任何实质性变更, 应当及时书面告知管理人或其销售机构;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(9) 不得从事任何有损本集合计划及

行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，应当予以制止；

(5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

(6) 按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；

(7) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(8) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

(9) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(10) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

(11) 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(13) 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

(三) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定

其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等；不得利用本集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 保证其享有签署包括本合同在内的集合计划相关文件的权利，并就签署行为已履行必要的批准或授权手续，且签署和履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定；

(12) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划期间持续有效，如相关情况出现变化需及时告知管理人，管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理，份额持有人将予以配合并承担相关后果和损失；

(13) 不得违规转让其所拥有的集合计划份额；

(14) 如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料，防止他人以份额持有人名义实施电子签名行为；

(15) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(二) 管理人的权利和义务

1、管理人的权利

(1) 按照本合同约定，独立管理和运用集合计划财产，以管理人的名义，代表集合计划与其他第三方签署集合计划投资文件；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬(如有)；

(3) 按照有关规定和本合同约定行使因集合计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会

和本合同、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

## 2、托管人的义务

(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况；

(6) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；

(10) 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于十五年；

(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担

相关派出机构及基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为本集合计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表本集合计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 在法律法规规定范围内，根据市场情况对本集合计划的认购、参与业务规则（包括但不限于集合计划总规模、单个投资者首次认购、参与金额、每次参与金额及持有的本集合计划总金额限制等）进行调整；

(8) 按照投资者适当性管理、反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查等相关法规、监管规定和内部制度要求，对投资者进行尽职调查、审核，要求投资者签署、提交声明、告知书等相关文件，对不符合准入条件或本合同约定的投资者，管理人有权拒绝接受其认购、参与申请；

(9) 如委托财产投资出现投资标的到期无法变现、交易对手违约或其他任何争议、纠纷，管理人有权聘请律师事务所进行处理，处理前述事项的相关费用由资产管理计划委托财产承担；

(10) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

## 2、管理人的义务

(1) 依法办理集合计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照基金业协会要求报送集合计划产品运行信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用集合计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(5) 制作《风险揭示书》，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员

<p>赔偿责任;</p> <p>(14)因管理人过错造成集合计划资产损失的,代委托人向管理人追偿;</p> <p>(15)法律法规、本合同及《托管协议》约定的其他义务。</p>	<p>进行投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作集合计划财产;</p> <p>(7)建立健全的内部管理制度,保证本集合计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立,对所管理的不同财产分别管理,分别记账,分别投资;聘请投资顾问的,应制定相应利益冲突防范机制;</p> <p>(8)除依据法律法规、本合同及其他有关规定外,不得为管理人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作集合计划财产;</p> <p>(9)保守商业秘密,不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等,依法依规提供信息的除外;</p> <p>(10)公平对待所管理的不同财产,不得从事任何有损集合计划财产及其他当事人利益的活动;</p> <p>(11)除规定情形或符合规定条件外,不得为管理人、托管人及其关联方提供融资;</p> <p>(12)按照本合同约定接受份额持有人和托管人的监督;</p> <p>(13)以管理人的名义,代表份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为,管理人因行使上述权利或实施法律行为产生的费用由集合计划财产承担;</p> <p>(14)按照本合同约定计算并向份额持有人报告集合计划份额净值;</p> <p>(15)确定集合计划份额参与、退出价格,采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定;</p> <p>(16)对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查,形成书面工作底稿,并制作尽职调查报告;</p> <p>(17)按照本合同约定负责集合计划会计核算并编制财务会计报告;</p> <p>(18)聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;</p> <p>(19)按照本合同的约定确定收益分配方案,及时向份额持有人分配收益;</p>
--	--

(20) 根据法律法规与本合同的规定, 编制向份额持有人披露的集合计划季度、年度等定期报告, 向基金业协会备案, 并抄报中国证监会相关派出机构;

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;

(22) 建立并保存份额持有人名单;

(23) 组织并参加集合计划财产清算小组, 参与集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(24) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定, 保存集合计划的会计账册, 妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自集合计划终止之日起不得少于 20 年;

(25) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知托管人和份额持有人;

(26) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

### (三) 托管人的权利与义务

#### 1、托管人的权利

(1) 按照本合同约定, 依法保管集合计划财产;

(2) 按照本合同约定, 及时、足额获得集合计划托管费用;

(3) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

#### 2、托管人的义务

(1) 安全保管集合计划财产;

(2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外, 不得为托管人及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管集合计划财产;

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户, 确保集合计划财产的完整与独立;

(4) 公平对待所托管的不同财产, 不得从事任何有损集合计划财产及其他当事人利益的活动;

(5) 按规定开立和注销集合计划的托管账户及其他投资所需账户;

(6) 复核集合计划资产净值和份额净值;

	<p>(7) 办理与集合计划托管业务有关的信息披露事项;</p> <p>(8) 根据相关法律法规和本合同约定, 复核管理人编制的集合计划财产的定期报告, 并出具书面意见;</p> <p>(9) 编制托管年度报告;</p> <p>(10) 按照法律法规要求和本合同约定, 根据管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;</p> <p>(11) 保守商业秘密, 除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外, 不得向他人泄露;</p> <p>(12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存集合计划的会计账册, 妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料, 保存期限自集合计划终止之日起不得少于 20 年;</p> <p>(13) 监督管理人的投资运作, 发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的, 应当拒绝执行, 立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会;</p> <p>(14) 向管理人提供托管人关联方名单, 并在上述名单有变化时向管理人提供最新名单;</p> <p>(15) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知管理人和份额持有人;</p> <p>(16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。</p>
<p>二十三、违约责任与争议处理</p>	
<p>(一) 违约责任</p> <p>.....</p> <p>(4) 在计划运作过程中, 管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责, 但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 违约责任</p> <p>.....</p> <p>(4) 在计划运作过程中, 管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责, 但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。</p> <p>(5) 管理人、托管人对因使用证券交易所、中登公司、证券期货经纪商等其</p>

	<p>他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任;</p> <p>(6) 交易所、中登公司实施证券交易资金前端风险控制, 委托人同意由管理人自行决定向交易所申报的资金前端控制自设额度, 因管理人关联交易单元的全天净买入申报金额总量达到或超过自设额度, 导致本计划下的交易申报不成功、投资无法实现的, 管理人、托管人免责。因交易所、中登公司实施资金前端控制出现异常及在在异常情况下交易所、中登公司采取的相应措施造成委托资产损失的, 管理人、托管人免责。</p> <p>.....</p>
<p>二十四、风险揭示</p>	
<p>(一) 市场风险</p> <p>5、购买力风险</p> <p>本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值, 如果发生通货膨胀, 集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消, 从而影响集合计划资产的保值增值。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 市场风险</p> <p>5、购买力风险</p> <p>本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值, 如果发生通货膨胀, 集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消, 从而影响集合计划资产的保值增值。</p> <p>6、新股申购风险</p> <p>新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股可能存在有一定的锁定期, 锁定期间股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响, 股票价格有可能下跌到申购价以下。</p> <p>7、衍生品风险</p> <p>金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈, 会放大收益或损失, 在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。</p> <p>.....</p> <p>(三) 参与、退出风险</p> <p>本集合计划成立日起满 3 个月后每月开放一次参与和退出, 在封闭期内, 投资者面临不能退出的风险。若投资者错过某一开放期而未能退出, 至下一开</p>

放期方可退出。本集合计划在《集合资产管理合同》约定的特定情形下可能发生拒绝或暂停参与及/或退出的情形，投资者面临不能参与及/或不能退出的风险。

由于投资者在开放期大额退出、巨额退出而导致管理人被迫抛售持有投资品种以应付投资者退出的现金需要，则可能使集合计划资产净值受到不利影响。因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额退出，并导致管理人的现金支付出现困难，巨额退出被管理人全部确认的投资者仍有可能存在延缓支付退出款项的风险，巨额退出全部或部分未被管理人确认的投资者仍有可能承担短期内变现而带来的冲击成本对集合计划净资产产生的负面影响。在确保投资者得到公平对待的前提下，管理人可依照本合同的约定，对退出申请等进行适度调整，作为特定情形下流动性风险管理措施，包括但不限于：（1）延期办理巨额退出申请；（2）暂停或拒绝接受退出申请；（3）延缓支付退出款项；（4）摆动定价；（5）中国证监会认定的其他措施。前述流动性风险管理措施可能对投资者存在如下影响：

（1）当前一估值日集合计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，或发生其他本合同约定的情形，管理人有权拒绝或暂停接受退出申请的措施。投资者存在不能及时退出的风险。

（2）若本集合计划在开放期发生了巨额退出，管理人有可能采取延缓支付赎回款项、延期办理、暂停或拒绝办理的措施以应对巨额退出，具体措施请见本合同的约定。因此在巨额退出情形发生时，投资者可能会遇到延缓支付赎回款项、延期办理、暂停或拒绝办理等风险。同时投资者完成退出时的集合计划份额净值可能与其提交退出申请时的集合计划份额净值不同。

（3）当本集合计划发生大额参与或退

.....  
（五）本集合计划的特有风险  
本集合计划主要通过参与银河金

汇量化2号结构化集合资产管理计划A类份额来实现收益，而银河金汇量化2号结构化计划将通过投资于证券公司集合资产管理计划以及现金类金融产品实现其投资目标、投资理念和投资策略。根据《银河金汇量化2号结构化集合资产管理计划集合资产管理合同》及银河金汇量化2号结构化计划主要投资的证券公司集合资产管理计划的相关法律文件，银河金汇量化2号结构化计划投资者面临以下特有风险：

### 1、流动性风险

受市场价格、投资者情绪、监管措施等诸多因素影响，证券市场流动性在不同时期的表现是不均衡的。在产品投资操作中，由于市场流动性匮乏导致在进行个股或个券操作时，无法按照当前价格完成计划数量的买入或卖出交易，将可能会使得产品无法达到预期的投资效果。

### 2、信用风险

信用风险是指所投银河金汇量化2号结构化计划的管理人违约、拒绝支付到期本息，或者在交易过程中发生交收违约，从而导致集合计划财产损失的风险。

3、本计划参与银河金汇量化2号结构化计划A类份额，银河金汇量化2号结构化计划A类份额投资者面临以下投资风险：

#### (1) 强制退出风险

当某类份额资产净值:另一类份额资产净值超过1.3:1或当A类份额数:B类份额数超过1:1，按照《银河金汇量化2号结构化集合资产管理计划资产管理合同》约定，将对超额份额实施强制退出。上述操作可能对A类份额持有人带来风险。

#### (2) 巨额申赎递延风险

按照《银河金汇量化2号结构化集合资产管理计划资产管理合同》约定，在单个开放日，净申赎的某类份额数（退出申请份额总数扣除申购申请份额总数的余额）超过上一日总份额的

出情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。当日参与或退出的投资者存在承参与或退出产生的交易及其他成本的风险。

.....

### (八) 监管政策风险

因法律法规、政策、监管规定（包括但不限于监管/主管部门或自律组织出台与本合同项下业务相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）对集合计划管理和运作安排的要求的不确定性及任何变化，均可能导致本计划备案时被要求调整或备案最终失败，或在运行过程中被要求调整或提前终止，导致无法及时开始投资或投资安排无法实现或无法正常投资等。在该等情况下，管理人将依据法律法规和监管要求对本计划进行调整或提前终止本计划，可能影响投资人的投资计划和投资收益。

本集合计划成立后合同变更后，相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人所在地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。备案中协会可能一次或多次要求管理人对本合同进行补正，管理人届时与托管人就本合同补正达成一致后公告补正后的合同，委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。本集合计划在协会备案通过后方开始投资运作，如本集合计划未能及时通过备案将导致无法及时开展投资运作。

如本集合计划始终未通过中国证券投资基金业协会备案，管理人有权按照本合同提前终止本计划。

### (九) 关联交易风险

管理人根据集合资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循集合计划份额持有人委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因

8%时，即认为发生了巨额申赎。当出现巨额申赎时，管理人可根据当时的资产组合状况决定全额确认、部分递延、暂停确认或管理人认为合理其他方式，该处理方式可能给某类份额投资者带来风险。

### (3) 收益风险

A类份额收益为标的指数收益率+年化指数增强强度，如果市场出现大幅波动，标的指数收益率亦将相应波动，这将会给A类份额持有人的收益带来风险。A类份额业绩比较基准并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。A类份额可能出现净值损失。

## 4、投资证券公司集合资产管理计划的特有风险

银河金汇量化2号结构化计划管理人主要通过投资于证券公司集合资产管理计划以及现金类金融产品实现该集合计划的投资目标、投资理念和投资策略。

(1) 证券公司集合资产管理计划的管理人无法承诺资产管理计划利益的风险。

根据相关法律规定，资产管理计划的管理人不对资产管理计划的委托人作出委托资产不受任何损失或做出任何保证委托资产收益的承诺，从而使集合计划面临相应风险。

(2) 委托财产无法变现的风险。

证券公司集合资产管理计划终止时，受市场环境或其他原因影响，委托资产可能部分或者全部不能变现，并可能以委托资产原状方式(包括但不限于债权、股权、资产收益权等)向资产管理计划委托人分配，因此委托人可能面临计划终止时无法及时或足额收到资产管理计划利益的风险。

(3) 计划终止的风险。

若证券公司集合资产管理计划持有债券、类固定收益产品及非标准化债权及其他资产提前变现或因法律、法规及监管规定及本合同约定的其他原因

管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果(就投资结束后的实际损益情况而言)比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的，本集合计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对集合计划的投资收益造成影响。

### (十) 税收风险

本集合计划项下的计划财产应按有相关法律法规规定承担相应的税费，如财税【2017】56号文项下的增值税等，且随着国家财税政策的变化，应当由计划财产承担的税费可能发生变化，从而导致委托人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少。如果国家相关税务政策出台或发生变化，本计划项下投资需要依法履行纳税义务的，资产委托人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少，亦可能由资产委托人向本计划或资产管理人另行支付相关税费。

### (十一) 资金前端控制风险

根据交易所、中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)的相关规定，交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度的额度。如果本计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，交易所将拒绝接

导致计划提前终止的，资产委托人可能不能获得满意的投资收益。

#### (4) 证券公司集合资产管理计划关联交易风险

证券公司集合资产管理计划可能进行关联交易投资，存在关联交易的风险。

#### (5) 法律与政策风险

宏观经济政策、产业政策、财政政策、货币政策、资本市场政策和监管政策等国家政策的变化及相关法律、行政法规、部门规章的调整与变化将对经济运行和投资项目产生一定影响，可能直接或者间接影响投资收益和资产管理计划财产。

### 5、投资股指期货的特有风险

本集合计划主要投资的银河金汇量化2号结构化计划及其主要投资的证券公司集合资产管理计划的投资范围包括股指期货，面临以下特有风险：

#### (1) 股指期货的市场风险

由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失；股指期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，因此投资者进行股指期货交易会面临较大的市场风险。

#### (2) 信用风险

对于股指期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行股指期货交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

#### (3) 结算风险

投资者金融期货投资的结算及投

受该笔交易及该关联交易单元后续竞价交易买入申报，本计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于是否在申请时间内、中登公司及交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，仍然存在无法及时完成投资的风险。因上述原因可能导致管理人无法完成投资，影响投资收益、给委托资产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。因资金前端控制异常情况交易所、中国结算采取的相应措施可能影响管理人的投资，影响委托资产的投资收益、给委托资产造成损失。

#### (十二) 适当性管理相关风险

1、投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人评定投资者的风险承受能力、做出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下做出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

2、委托人在信息发生重要变化、可能影响管理人对其做出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人，以便管理人做出调整。若委托人未能及时有效告知管理人，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生的相应风险、责任、损失应由委托人自行承担。

3、委托人或产品的信息发生变化时，

投资者金融期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。证券投资者如果选择了不具有合法证券经纪业务资格的证券及期货经纪公司从事证券交易，投资者权益将无法得到法律保护；或者所选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，也可能给投资者带来损失。

对从事股指期货的投资者来说，为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，投资者的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

股指期货持续大幅贴水，基差大幅波动也可能给投资者带来损失。

#### （4）模型风险

集合计划的投资依赖各种量化投资模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，数量模型的可靠性将对本集合的收益产生影响。同时，量化模型对相关数据的准确性和可靠性依赖较高，个别研究报告或其它材料的数据是否准确可靠，对本集合计划的业绩表现有所影响。市场上蓝筹股与中小盘出现较大幅度背离，对冲策略也会面临较大的模型风险。

#### （5）政策风险

市场出台限制股指期货交易的政策会影响股指期货的流动性，并对模型产生一定的影响，影响集合资产管理计划按照模型交易并产生风险。

#### （六）关联交易风险

管理人根据集合资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能被监

管理人有权主动调整委托人的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见，此时管理人应告知委托人上述情况，并承担未履行告知义务的相关责任。管理人做出主动调整的，委托人的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

#### （十三）集合资产管理合同终止风险

发生本合同第二十一条第（一）款及第（二）款约定的情形，且管理人决定终止等，管理人可能提前终止本集合计划将提前终止，投资者面临集合计划终止及清算的风险。

#### （十四）本集合计划特有风险

##### 1、投资于基金的特定风险

本计划投资于基金公司的基金产品，可能由于其管理人的投资失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成本资产管理计划净值的下降，最终导致委托人资产损失。此类产品的管理人的管理能力、投资水平、信用状况等因素及相关托管人的资质与信用等因素都可能影响此类产品的收益、盈亏，从而导致本计划的收益、盈亏受到影响。基金产品间接投资于证券市场，证券市场价格因受各种因素的影响而引起波动，从而间接影响本计划的业绩。包括但不限于如下风险：

##### （1）开放期不匹配的风险

本计划的募集期、清算期与所投资的基金产品的开放期可能不完全匹配，基金财产可能存在闲置情况。

##### （2）流动性风险

本计划投资于基金产品，在赎回时，可能因为没有足够流动性资产或资产无法及时变现，而导致无法及时收到赎回款，进而影响到本计划的流动性或资金运用。

##### （3）估值相关风险

本计划投资基金产品，可能存在估值时间不一致、披露时间不一致的情况，本计划按照基金产品的管理人所提供的最近的单位净值或本合同约定的

管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，也可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。（七）其它风险

- 1、因投资者退出导致集合计划份额持有人少于2人而被强制退出的风险；
- 2、由于集合计划认购门槛较高，导致募集资金达不到成立条件的风险；
- 3、当集合计划资产净值低于1000万，或者当发生影响或可能影响本集合计划运作的情形（包括但不限于银河金汇量化2号结构化计划终止，市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见等），管理人可能提前终止本集合计划的风险；
- 4、管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；
- 5、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险；
- 6、在集合资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等；
- 7、管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险；
- 8、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失，从而带来风险；
- 9、如委托人以电子签名方式签署本合同，在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障，从而导致电子签名合同无法及时签订，从而影响委托人的投资收益。电子签名合同签订后，委托人凭密码进行交易，委托人通过密码登录后所有操作均将视同本人行为，如委托人设

其他方法进行估值。在存续期间，本计划的估值可能无法反映真实投资管理情况。

#### （4）双重收费风险

本计划的委托人可能需要承担双层费用，即本计划费用及本计划所投资的基金产品自身需要承担的费用，例如认购费（参与费）、赎回费（退出费）、管理费、投资顾问费用（如有）、托管费及业绩报酬（如有）等，以上费用在计提时将会扣减本计划投资基金产品的净值，从而造成本计划净值下降。

#### 3、投资债券回购的特有风险：

（1）信用风险：逆回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成计划净值损失的风险；

#### 4、期货的特有风险：

（1）杠杆风险。由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，标的证券或标的指数微小的变动就可能使权益遭受较大损失；股指期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，因此进行股指期货交易会面临较大的市场风险。

（2）流动性风险。在某些市场情况下，可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如市场达到涨跌停板或者无流动性，保证金可能无法弥补全部损失，本计划必须承担由此导致的全部损失。

（3）信用风险。对于期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行衍生品交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，

<p>置密码泄露,可能导致他人在未经授权的情况下操作委托人账户,给委托人造成潜在损失;</p> <p>10、其他不可预知、不可防范的风险。</p>	<p>或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。</p> <p>(4) 结算风险。进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足,或因其他原因导致期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时,本计划所投资资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。</p> <p>(5) 交割风险:当合约到期时,所有未平仓合约都要配对进行实物交割。不准备进行交割的期货投资应在合约到期之前将持有的未平仓合约及时平仓,否则需承担交割责任的风险。</p> <p>(十五) 其它风险</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、由于集合计划认购门槛较高,导致募集资金达不到成立条件的风险;</li> <li>2、在集合资产管理计划的日常交易中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等;</li> <li>3、管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中,因操作失误或违反操作规程而引起的风险;</li> <li>4、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致集合计划资产的损失,从而带来风险;</li> <li>5、如委托人以电子签名方式签署本合同,在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障,从而导致电子签名合同无法及时签订,从而影响委托人的投资收益。电子签名合同签订后,委托人凭密码进行交易,委托人通过密码登录后所有操作均将视同本人行为,如委托人设置密码泄露,可能导致他人在未经授权的情况下操作委托人账户,给委托人造成潜在损失;</li> <li>6、其他不可预知、不可防范的风险。</li> </ol>
---	--

说明:

1. 请委托人仔细阅读表中标黄部分;